

华安乐惠保本混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年二月九日

1 重要提示

华安乐惠保本混合型证券投资基金(以下简称本基金),系经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)证监许可[2015]2780号《关于准予华安乐惠保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由华安基金管理有限公司作为管理人自2015年12月8日至2015年12月28日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第60971571_B43号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年12月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,份额注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

华安乐惠保本混合型证券投资基金为保本基金,保本周期为两年,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华安乐惠保本混合型证券投资基金合同》(以下简称《基金合同》或基金合同)及监管机构的相关规定,如保本周期届满时,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将根据《基金合同》的约定直接进入清算程序并终止《基金合同》。

根据2017年1月24日中国证监会发布的《关于避险策略基金的指导意见》(简称《意见》),现有保本基金在保本周期到期后若不能变更注册为避险策略基金,均需转型为其他类型基金或清盘。鉴于本基金不再符合保本基金的存续条件且未转型为其他类型基金,因此,在第一个保本周期到期后,本基金将按照《意见》的要求并根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止。本基金最后运作日为2018年1月2日,自2018年1月3日进入清算期。

由基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2018年1月3日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

2 基金产品概况

基金简称 华安乐惠保本混合

基金主代码 002238

基金运作方式 契约开放式

基金合同生效日 2015年12月30日

报告期末(2018年1月2日)基金份额总额 3,573,973,974.33份

投资目标 通过运用投资组合保险技术,有效控制本金损失的风险,在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。

投资策略 本基金采用基于VaR的风险乘数全程可变的CPPI策略(恒定比例组合保险策略)。基金管理人主要通过数量分析,根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数(即风险乘数),动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例,以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现投资组合的保本增值目标。同时,本基金将通过分析宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,分析和比较不同证券市场 and 不同金融工具的收益及风险特征,确定具体的投资券种选择,积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。

业绩比较基准 人民币两年期银行定期存款收益率(税后)

风险收益特征 本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

基金管理人 华安基金管理有限公司

基金托管人 中国民生银行股份有限公司

3 基金运作情况概述

华安乐惠保本混合型证券投资基金(以下简称本基金),系经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)证监许可[2015]2780号《关于准予华安乐惠保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由华安基金管理有限公司作为管理人自2015年12月8日至2015年12月28日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第60971571_B43号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年12月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,份额注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

华安乐惠保本混合型证券投资基金为保本基金,保本周期为两年,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华安乐惠保本混合型证券投资基金合同》(以下简称《基金合同》或基金合同)及监管机构的相关规定,如保本周期届满时,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将根据《基金合同》的约定直接进入清算程序并终止《基金合同》。

根据2017年1月24日中国证监会发布的《关于避险策略基金的指导意见》(简称《意见》),现有保本基金在保本周期到期后若不能变更注册为避险策略基金,均需转型为其他类型基金或清盘。鉴于本基金不再符合保本基金的存续条件且未转型为其他类型基金,因此,在第一个保本周期到期后,本基金将按照《意见》的要求并根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止。本基金最后运作日为2018年1月2日,自2018年1月3日进入清算期。

4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体:华安乐惠保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018年1月2日

单位:人民币元

资产 最后运作日

2018年1月2日

资产:

银行存款 3,717,631,586.95

结算备付金 716,454.54

存出保证金 94,047.94

交易性金融资产 22,538,773.52

其中:股票投资 22,538,773.52

应收利息 365,853.80

资产总计 3,741,346,716.75

负债和所有者权益 最后运作日

2018年1月2日

负债:

应付管理人报酬 3,379,555.24

应付托管费 506,933.28

应付销售服务费 358,369.03

应付交易费用 42,408.65

其他负债 9,000.00

负债合计 4,296,266.20

所有者权益:

实收基金 3,573,973,974.33

未分配利润 163,076,476.22

所有者权益合计 3,737,050,450.55

负债和所有者权益总计 3,741,346,716.75

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)专字第 60971571_B02 号标准无保留意见的审计报告。

5 基金财产分配

自 2018 年 1 月 3 日至 2018 年 1 月 9 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金人民币 716,454.54 元，为存放于上海证券交易所和深圳证券交易所的结算备付金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 1 月 3 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 94,047.94 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 1 月 3 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 22,538,773.52 元，系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票，明细如下：（金额单位：人民币元）

股票代码 股票名称 停牌日期 停牌原因 终止日估值单价 数量 终止日成本总额 终止日估值总额

（单位：股）

002366 台海核电 2017/12/6 重大事项停牌 26.45 435,400 11,070,545.96 11,516,330.00

002694 顾地科技 2017/5/25 重大事项停牌 15.36 717,607 17,382,382.53 11,022,443.52

根据《华安乐惠保本混合型证券投资基金基金合同》第十六部分基金资产估值的约定，交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。流通受限证券台海核电最后运作日的估值单价为停牌前一交易日的收盘价，流通受限证券顾地科技最后运作日的估值单价的系本基金管理人华安基金管理有限公司运用估值技术计算而得。

根据《关于华安乐惠保本混合型证券投资基金保本周期到期基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金管理人华安基金管理有限公司将以自有资金按照基金所持有证券资产最后运作日的估值价格垫付基金未能变现的证券资产，具体清算规则按照相关规定办理。待停牌证券复牌后，为保证基金资产流动性，基金管理人将及时变现停牌证券。待全部停牌证券复牌并卖出变现后，若变现金额高于基金管理人垫付的金额，则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额小于基金管理人垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 1 月 3 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 365,853.80 元。其中应收银行存款利息人民币 365,416.04 元，应收结算备付金利息人民币 386.88 元，应收存出保证金利息人民币 50.88 元，上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 1 月 3 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,379,555.24 元，该款项已于 2018 年 1 月 3 日及 2018 年 1 月 5 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 506,933.28 元，该款项已于 2018 年 1 月 3 日及 2018 年 1 月 5 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 358,369.03 元，该款项已于 2018 年 1 月 3 日及 2018 年

1月5日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 42,408.65 元，为银行间交易结算费用，该款项将于 2018 年 1 月 9 日后支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 9,000.00 元，为银行间账户维护费，该款项将于 2018 年 1 月 9 日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目 自 2018 年 1 月 3 日

至 2018 年 1 月 9 日

止清算期间

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 154,885.51

清算收入小计 154,885.51

二、清算费用

清算费用小计（注 2） -

三、清算净收益 154,885.51

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 1 月 3 日至 2018 年 1 月 9 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息和结算备付金利息。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 1 月 3 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

注 2：根据《关于华安乐惠保本混合型证券投资基金保本周期到期基金合同终止及基金财产清算的公告》，本次清算期间产生的清算费用由本基金管理人代为支付。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 1 月 2 日基金净资产 3,737,050,450.55

加：清算期间净收益 154,885.51

减：基金净赎回转出金额（于 2018 年 1 月 3 日确认的投资者赎回转出申请） 3,682,626,557.07

二、2018 年 1 月 9 日基金净资产 54,578,778.99

根据本基金的基金合同及《关于华安乐惠保本混合型证券投资基金保本周期到期基金合同终止及基金财产清算的公告》，将基金财产清算后的全部剩余资产交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2018 年 1 月 9 日止的剩余财产为人民币 54,578,778.99 元，其中包括本基金管理人为了最大化保护基金份额持有人的利益而根据本基金所持停牌股票（台海核电）及未出售股票（顾地科技）最后运作日的估值价格垫付的等价现金。待该等股票变现后，若其变现金额高于该等股票最后运作日的估值价格，则该差额将按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人，若变现金额小于该等股票最后运作日的估值价格，则由基金管理人承担相应损失。

截至 2018 年 1 月 9 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 57,474,298.41 元，其中人民币 39,099,660.61 元系基金管理人代垫的结算备付金、存出保证金、按照最后运作日的估值价格垫付基金未能变现的股票资产以及以当前适用的利率预估的银行存款、结算备付金及存出保证金利息。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、华安乐惠保本混合型证券投资基金 2018 年 1 月 2 日资产负债表及审计报告

2、《华安乐惠保本混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安乐惠保本混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一八年一月九日